

# 野村アジアCB投信 (毎月分配型)

## 運用報告書(全体版)

第131期(決算日2021年5月20日) 第132期(決算日2021年6月21日) 第133期(決算日2021年7月20日)  
第134期(決算日2021年8月20日) 第135期(決算日2021年9月21日) 第136期(決算日2021年10月20日)

作成対象期間(2021年4月21日~2021年10月20日)

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券	
信託期間	2010年6月3日から2025年4月21日までです。	
運用方針	主として、円建ての外国投資信託であるノムラ・カレンシー・ファンドアジア CB ファンドークラスASC受益証券および円建ての国内籍の投資信託である野村マネー マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除くアジア諸国・地域の企業が発行する高利回りの転換社債(CB)を実質的な主要投資対象とし、高水準のインカムゲインの確保とキャピタルゲインの獲得を目的として運用を行ないます。各受益証券への投資比率は、通常の状況においては、ノムラ・カレンシー・ファンドアジア CB ファンドークラスASC受益証券への投資を中心としますが、特に制限は設けず、各投資対象ファンドの収益性および流動性ならびに当ファンドの資金動向等を勘案のうえ決定します。	
主な投資対象	野村アジアCB投信 (毎月分配型)	ノムラ・カレンシー・ファンドアジア CB ファンドークラスASC受益証券および野村マネー マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
	ノムラ・カレンシー・ファンド アジア CB ファンドークラス ASC	日本を除くアジア諸国・地域の企業が発行する高利回りの転換社債を主要投資対象とします。
	野村マネー マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村アジアCB投信 (毎月分配型)	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行ないません。
	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行ないません。
分配方針	毎決算時に、原則として、利子・配当等収益等を中心に安定分配を行なうことを基本とします。ただし、基準価額水準等によっては売買益等が中心となる場合や安定分配とならない場合があります。なお、毎年4月および10月の決算時には、安定分配相当額に委託者が決定する額を付加して分配する場合があります。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。 「原則として、利子・配当等収益等を中心に安定分配を行なう」方針としていますが、これは、運用による収益が安定したものになることや基準価額が安定的に推移すること等を示唆するものではありません。	

## 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104  
(受付時間) 営業日の午前9時~午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近30期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	標準価額			債 組 入 比	券 率	債 先 物 比	券 率	投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 金 騰 落						
	円		円		%	%	%	%	百万円	
107期(2019年5月20日)	8,069		20	△ 5.2	0.0	—	—	98.3	4,160	
108期(2019年6月20日)	8,034		20	△ 0.2	0.0	—	—	98.7	4,116	
109期(2019年7月22日)	8,179		20	2.1	0.0	—	—	98.9	4,174	
110期(2019年8月20日)	7,768		20	△ 4.8	0.0	—	—	98.0	3,938	
111期(2019年9月20日)	7,985		20	3.1	0.0	—	—	98.1	3,931	
112期(2019年10月21日)	7,967		20	0.0	0.0	—	—	97.7	3,825	
113期(2019年11月20日)	8,059		20	1.4	0.0	—	—	98.6	3,829	
114期(2019年12月20日)	8,249		20	2.6	0.0	—	—	98.7	3,853	
115期(2020年1月20日)	8,582		20	4.3	0.0	—	—	98.4	3,964	
116期(2020年2月20日)	8,465		20	△ 1.1	0.0	—	—	98.9	3,629	
117期(2020年3月23日)	7,188		20	△14.8	0.0	—	—	98.0	3,049	
118期(2020年4月20日)	7,259		20	1.3	0.0	—	—	98.0	3,070	
119期(2020年5月20日)	7,540		20	4.1	0.0	—	—	98.0	3,182	
120期(2020年6月22日)	7,863		20	4.5	0.0	—	—	98.3	3,301	
121期(2020年7月20日)	8,009		20	2.1	0.0	—	—	98.0	3,317	
122期(2020年8月20日)	8,112		20	1.5	0.0	—	—	98.4	3,286	
123期(2020年9月23日)	8,208		20	1.4	0.0	—	—	97.5	3,296	
124期(2020年10月20日)	8,283		20	1.2	0.0	—	—	98.1	3,300	
125期(2020年11月20日)	8,487		20	2.7	0.0	—	—	97.5	3,343	
126期(2020年12月21日)	8,629		20	1.9	0.0	—	—	97.8	3,384	
127期(2021年1月20日)	9,325		20	8.3	0.0	—	—	98.6	3,624	
128期(2021年2月22日)	9,833		20	5.7	0.0	—	—	97.7	3,797	
129期(2021年3月22日)	9,902		20	0.9	0.0	—	—	98.4	3,790	
130期(2021年4月20日)	9,953		20	0.7	0.0	—	—	98.6	3,796	
131期(2021年5月20日)	10,119		20	1.9	0.0	—	—	97.7	3,788	
132期(2021年6月21日)	10,323		20	2.2	0.0	—	—	98.0	3,845	
133期(2021年7月20日)	10,125		20	△ 1.7	0.0	—	—	98.2	3,756	
134期(2021年8月20日)	9,801		20	△ 3.0	0.0	—	—	98.4	3,618	
135期(2021年9月21日)	9,860		20	0.8	0.0	—	—	97.5	3,617	
136期(2021年10月20日)	10,218		20	3.8	0.0	—	—	97.9	3,729	

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

\* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

\* 当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準	価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
			騰 落 率	率			
第131期	(期 首) 2021年 4 月20日	円 9,953	% —	% 0.0	% —	% 98.6	
	4 月末	10,160	2.1	0.0	—	98.6	
	(期 末) 2021年 5 月20日	10,139	1.9	0.0	—	97.7	
第132期	(期 首) 2021年 5 月20日	10,119	—	0.0	—	97.7	
	5 月末	10,386	2.6	0.0	—	97.8	
	(期 末) 2021年 6 月21日	10,343	2.2	0.0	—	98.0	
第133期	(期 首) 2021年 6 月21日	10,323	—	0.0	—	98.0	
	6 月末	10,420	0.9	0.0	—	98.1	
	(期 末) 2021年 7 月20日	10,145	△1.7	0.0	—	98.2	
第134期	(期 首) 2021年 7 月20日	10,125	—	0.0	—	98.2	
	7 月末	9,930	△1.9	0.0	—	98.4	
	(期 末) 2021年 8 月20日	9,821	△3.0	0.0	—	98.4	
第135期	(期 首) 2021年 8 月20日	9,801	—	0.0	—	98.4	
	8 月末	9,848	0.5	0.0	—	98.6	
	(期 末) 2021年 9 月21日	9,880	0.8	0.0	—	97.5	
第136期	(期 首) 2021年 9 月21日	9,860	—	0.0	—	97.5	
	9 月末	9,883	0.2	0.0	—	97.6	
	(期 末) 2021年10月20日	10,238	3.8	0.0	—	97.9	

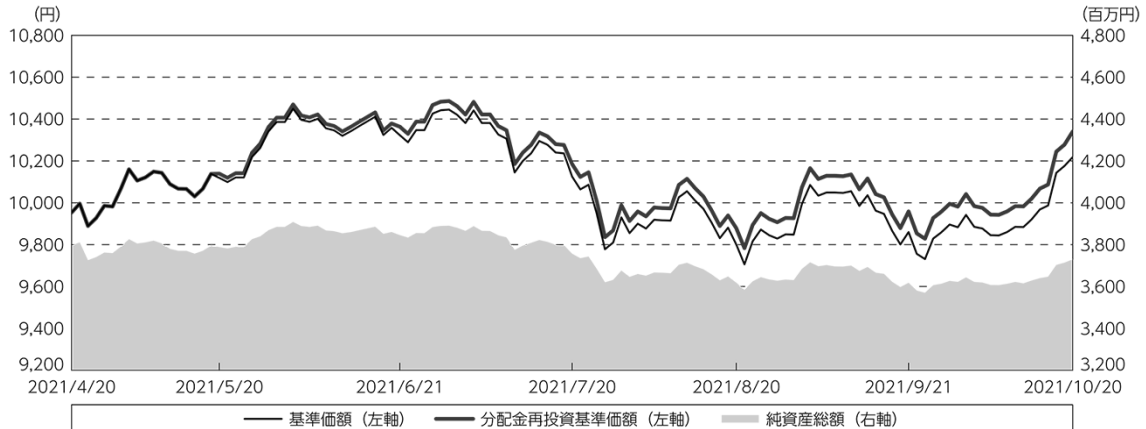
\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

\* 債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○作成期間中の基準価額等の推移



第131期首：9,953円

第136期末：10,218円（既払分配金（税込み）：120円）

騰落率：3.9%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2021年4月20日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

実質的に投資しているアジアCBからのインカムゲイン（利息収入）

実質的に投資しているアジアCBからのキャピタルゲイン（またはロス）（価格変動損益）

為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）またはプレミアム（金利差相当分の収益）

円／アジア通貨の為替変動

## ○投資環境

アジアCB市場（日本を除く）は、4月の中国製造業PMI（購買担当者景気指数）が市場予想を下回ったことや、米長期金利の上昇などを受け、5月半ばにかけて下落しました。その後、米長期金利上昇の一服感などから反発したものの、FRB（米連邦準備制度理事会）による早期利上げ観測の高まりや、中国政府による企業統制強化の動きなどを背景に軟調に推移しました。9月中旬以降は、中国の大手不動産会社の債務問題に対する懸念が高まったことなどから下落し、当作成期間では値下がりとなりました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村アジアCB投信（毎月分配型）]

[ノムラ・カレンシー・ファンドーアジア CB ファンドークラスASC] 受益証券および [野村マネー マザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [ノムラ・カレンシー・ファンドーアジア CB ファンドークラスASC] 受益証券への投資比率を、概ね90%以上に維持しました。

### [ノムラ・カレンシー・ファンドーアジア CB ファンドークラスASC]

主要投資対象である [ノムラ・カレンシー・ファンドーアジア CB ファンドークラスASC] のポートフォリオにおける信用格付け別比率については、9月末現在で、A格以上12.9%、BBB格29.1%、BB格35.0%、B格11.4%となりました。

\* 格付はS&P社あるいはムーディーズ社のいずれかの格付機関の低い方の格付によります。格付がない場合は副投資顧問会社が同等の信用度を有すると判断した格付によります。

### [野村マネー マザーファンド]

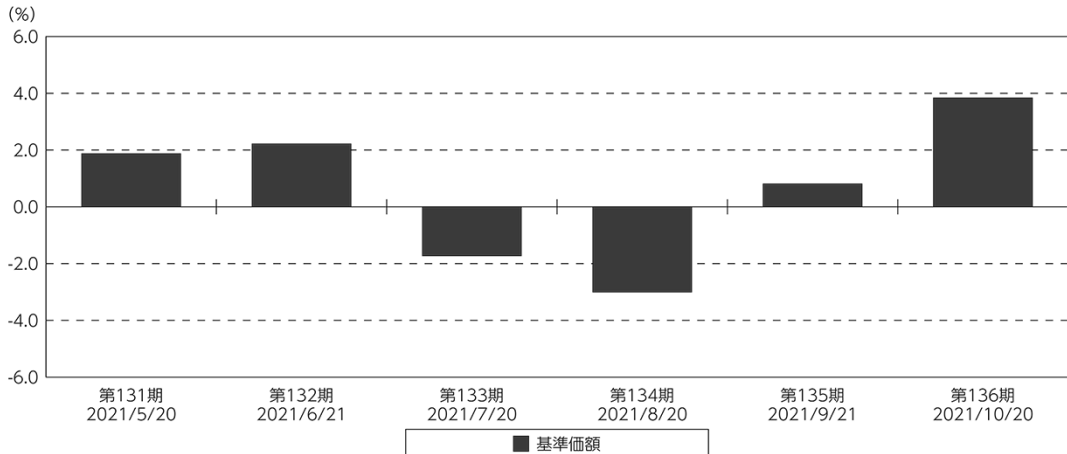
残存1年以内の公社債等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、主として外国籍ファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、作成期間中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。

基準価額（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## ○分配金

収益分配金については、各期の利子・配当収入や基準価額水準等を勘案し、信託報酬などの諸経費を差し引いた額をベースに決定しました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第131期	第132期	第133期	第134期	第135期	第136期
	2021年4月21日～ 2021年5月20日	2021年5月21日～ 2021年6月21日	2021年6月22日～ 2021年7月20日	2021年7月21日～ 2021年8月20日	2021年8月21日～ 2021年9月21日	2021年9月22日～ 2021年10月20日
当期分配金 (対基準価額比率)	20 0.197%	20 0.193%	20 0.197%	20 0.204%	20 0.202%	20 0.195%
当期の収益	20	20	20	20	20	20
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	3,981	4,006	4,024	4,042	4,065	4,091

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎今後の運用方針

### [野村アジアCB投信（毎月分配型）]

[ノムラ・カレンシー・ファンドーアジア CB ファンドークラスASC] 受益証券および [野村マネー マザーファンド] 受益証券を主要投資対象とし、投資の中心とする [ノムラ・カレンシー・ファンドーアジア CB ファンドークラスASC] 受益証券への投資比率を高位に維持します。

### [ノムラ・カレンシー・ファンドーアジア CB ファンドークラスASC]

日本を除くアジア諸国・地域の企業が発行する高利回りのCBを主要投資対象とし、インカムゲインの確保とキャピタルゲインの獲得を目指して運用を行ないます。米ドル建て以外のアジアCBへの投資にあたっては、原則として、当該資産にかかる通貨を売り、米ドルを買う為替取引を行ないます。組入資産について、原則として、対アジア通貨（中国元、インドルピー、インドネシアルピアの3通貨のバスケット）での為替取引<sup>\*</sup>を行ないます。

<sup>\*</sup> 外貨建資産に対して実質的に、当該外貨建資産にかかる通貨売り中国元買いの為替取引、当該外貨建資産にかかる通貨売りインドルピー買いの為替取引、当該外貨建資産にかかる通貨売りインドネシアルピア買いの為替取引を行なうことで、保有する外貨建資産の3分の1程度ずつ各アジア通貨への実質的なエクスポージャー<sup>\*\*</sup>をとることをいいます。

<sup>\*\*</sup> 通貨への実質的なエクスポージャーとは、当該通貨に係る為替変動リスクに直接的にさらされている部分をいいます。

アジアCB市場のけん引役とも言える中国は、経済の先行きについては、不動産セクターに対する懸念も広がっていることから市場参加者の見方は依然慎重になっています。新型コロナウイルスについては、社会全体と金融市場の間で反応が異なっているほか、世界的にはワクチン導入のスピードも異なっており、アジア地域内では未だ十分なワクチンが行き届かず感染がみられています。結果、株式市場を中心にボラティリティ（価格変動性）の高い状態が続いており、今後の動向には注視が必要です。一方で、米国ではバイデン政権下において、株式市場は不安定な中でも上昇を続けています。このような状況では、長期的な見通しを堅持した投資行動を取ることが重要であると考えています。また、中国における汚職の掃や通信・IT・オートメーション化の推進、あるいはサービス業主体の経済への変革といった取り組みは、長期的に持続可能な成長の実現への第一歩であると考えられます。株式へのエクスポージャーを取りつつ、債券的特性による下値抵抗力に期待が持てるCBは、こうした市場環境下において、リスクとリターンのバランスが取れた有効な投資対象であると考えます。

なお、当ファンドは証拠金規制に則り、規制対象取引の評価損益について取引の相手方と証拠金の授受を行なう場合があります。

### [野村マネー マザーファンド]

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

<sup>\*</sup>店頭デリバティブ取引に関する国際的な規制強化について

店頭デリバティブ取引等の金融取引に関して、国際的に規制の強化が行なわれており、ファンドが実質的に活用する当該金融取引が当該規制強化等の影響をうけ、当該金融取引を行なうための担保として現金等を提供する必要がある場合があります。その場合、追加的に現金等を保有するため、ファンドの実質的な主要投資対象の組入比率が下がり、高位に組入れた場合に期待される投資効果が得られないことが想定されます。また、その結果として、実質的な主要投資対象を高位に組入れた場合と比べてファンドのパフォーマンスが悪化する場合があります。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

（2021年4月21日～2021年10月20日）

項 目	第131期～第136期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 52	% 0.513	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(20)	(0.193)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(31)	(0.303)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	( 2 )	(0.017)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	52	0.514	
作成期間の平均基準価額は、10,104円です。			

\* 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\* その他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

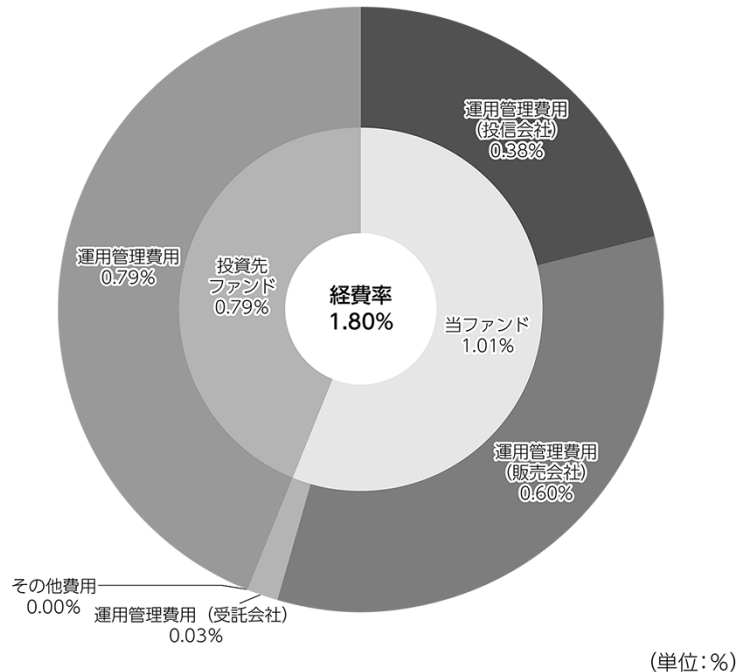
\* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



## （参考情報）

### ○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.80%です。



経費率 (①+②)	1.80
①当ファンドの費用の比率	1.01
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.79

(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## ○売買及び取引の状況

(2021年4月21日～2021年10月20日)

## 投資信託証券

銘柄		第131期～第136期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	ノムラ・カレンシー・ファンド-アジア CB ファンド-クラスASC	口 —	金額 千円 —	口 23,807	金額 千円 150,012

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年4月21日～2021年10月20日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村アジアCB投信（毎月分配型）&gt;

該当事項はございません。

&lt;野村マネー マザーファンド&gt;

区分	第131期～第136期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 7,860	百万円 30	% 0.4	百万円 —	百万円 —	% —

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2021年10月20日現在)

## ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	第130期末	第136期末		
	口数	口数	評価額	比率
ノムラ・カレンシー・ファンド-アジア CB ファンド-クラスASC	口 593,948	口 570,141	千円 3,651,182	% 97.9
合計	593,948	570,141	3,651,182	97.9

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

## 親投資信託残高

銘柄	第130期末	第136期末	
	口数	口数	評価額
野村マネー マザーファンド	千口 982	千口 982	千円 1,002

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2021年10月20日現在)

項目	第136期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 3,651,182	% 97.6
野村マネー マザーファンド	1,002	0.0
コール・ローン等、その他	89,793	2.4
投資信託財産総額	3,741,977	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第131期末	第132期末	第133期末	第134期末	第135期末	第136期末
	2021年5月20日現在	2021年6月21日現在	2021年7月20日現在	2021年8月20日現在	2021年9月21日現在	2021年10月20日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	3,800,724,788	3,863,529,462	3,769,768,345	3,630,145,185	3,639,184,311	3,741,977,513
コール・ローン等	100,443,616	93,286,937	79,894,745	66,895,852	110,719,684	89,792,289
投資信託受益証券(評価額)	3,699,278,814	3,769,240,167	3,688,871,340	3,562,247,073	3,527,462,367	3,651,182,964
野村マネー マザーファンド(評価額)	1,002,358	1,002,358	1,002,260	1,002,260	1,002,260	1,002,260
(B) 負債	12,469,896	18,123,540	13,102,962	11,788,136	21,407,105	12,259,960
未払収益分配金	7,487,455	7,450,146	7,420,560	7,383,477	7,337,982	7,300,196
未払解約金	1,790,027	7,209,492	2,553,418	1,196,631	10,787,659	2,009,283
未払信託報酬	3,185,494	3,456,399	3,122,206	3,201,094	3,274,343	2,944,078
未払利息	79	79	74	61	90	81
その他未払費用	6,841	7,424	6,704	6,873	7,031	6,322
(C) 純資産総額(A-B)	3,788,254,892	3,845,405,922	3,756,665,383	3,618,357,049	3,617,777,206	3,729,717,553
元本	3,743,727,601	3,725,073,331	3,710,280,364	3,691,738,564	3,668,991,498	3,650,098,059
次期繰越損益金	44,527,291	120,332,591	46,385,019	△ 73,381,515	△ 51,214,292	79,619,494
(D) 受益権総口数	3,743,727,601口	3,725,073,331口	3,710,280,364口	3,691,738,564口	3,668,991,498口	3,650,098,059口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,119円	10,323円	10,125円	9,801円	9,860円	10,218円

(注) 第131期首元本額は3,814,535,196円、第131～136期中追加設定元本額は9,622,814円、第131～136期中一部解約元本額は174,059,951円、1口当たり純資産額は、第131期1.0119円、第132期1.0323円、第133期1.0125円、第134期0.9801円、第135期0.9860円、第136期1.0218円です。

## ○損益の状況

項 目	第131期	第132期	第133期	第134期	第135期	第136期
	2021年4月21日～ 2021年5月20日	2021年5月21日～ 2021年6月21日	2021年6月22日～ 2021年7月20日	2021年7月21日～ 2021年8月20日	2021年8月21日～ 2021年9月21日	2021年9月22日～ 2021年10月20日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	17,493,090	17,280,828	17,287,675	17,323,459	17,274,799	17,044,176
受取配当金	17,494,318	17,283,357	17,289,634	17,325,205	17,276,211	17,046,341
支払利息	△ 1,228	△ 2,529	△ 1,959	△ 1,746	△ 1,412	△ 2,165
(B) 有価証券売買損益	55,132,778	69,590,162	△ 80,253,732	△ 126,324,221	14,939,694	123,702,834
売買益	55,631,139	69,962,474	131,059	296,830	15,223,420	123,754,466
売買損	△ 498,361	△ 372,312	△ 80,384,791	△ 126,621,051	△ 283,726	△ 51,632
(C) 信託報酬等	△ 3,192,335	△ 3,463,823	△ 3,128,910	△ 3,207,967	△ 3,281,374	△ 2,950,400
(D) 当期損益金(A+B+C)	69,433,533	83,407,167	△ 66,094,967	△ 112,208,729	28,933,119	137,796,610
(E) 前期繰越損益金	272,604,885	332,805,194	407,049,140	331,829,382	210,826,688	231,183,281
(F) 追加信託差損益金	△ 290,023,672	△ 288,429,624	△ 287,148,594	△ 285,618,691	△ 283,636,117	△ 282,060,201
(配当等相当額)	( 310,779,645)	( 309,713,522)	( 308,882,195)	( 307,675,556)	( 306,764,307)	( 305,696,778)
(売買損益相当額)	(△ 600,803,317)	(△ 598,143,146)	(△ 596,030,789)	(△ 593,294,247)	(△ 590,400,424)	(△ 587,756,979)
(G) 計(D+E+F)	52,014,746	127,782,737	53,805,579	△ 65,998,038	△ 43,876,310	86,919,690
(H) 収益分配金	△ 7,487,455	△ 7,450,146	△ 7,420,560	△ 7,383,477	△ 7,337,982	△ 7,300,196
次期繰越損益金(G+H)	44,527,291	120,332,591	46,385,019	△ 73,381,515	△ 51,214,292	79,619,494
追加信託差損益金	△ 290,023,672	△ 288,429,624	△ 287,148,594	△ 285,618,691	△ 283,636,117	△ 282,060,201
(配当等相当額)	( 310,779,645)	( 309,713,522)	( 308,882,195)	( 307,675,556)	( 306,764,307)	( 305,696,778)
(売買損益相当額)	(△ 600,803,317)	(△ 598,143,146)	(△ 596,030,789)	(△ 593,294,247)	(△ 590,400,424)	(△ 587,756,979)
分配準備積立金	1,179,737,252	1,182,577,948	1,184,270,059	1,184,804,474	1,184,777,497	1,187,611,588
繰越損益金	△ 845,186,289	△ 773,815,733	△ 850,736,446	△ 972,567,298	△ 952,355,672	△ 825,931,893

\* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

\* 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

\* 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2021年4月21日～2021年10月20日)は以下の通りです。

項 目	第131期	第132期	第133期	第134期	第135期	第136期
	2021年4月21日～ 2021年5月20日	2021年5月21日～ 2021年6月21日	2021年6月22日～ 2021年7月20日	2021年7月21日～ 2021年8月20日	2021年8月21日～ 2021年9月21日	2021年9月22日～ 2021年10月20日
a. 配当等収益(経費控除後)	16,724,417円	16,592,228円	14,159,015円	14,115,670円	15,515,536円	16,687,066円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越大損金補償後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	310,779,645円	309,713,522円	308,882,195円	307,675,556円	306,764,307円	305,696,778円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,170,500,290円	1,173,435,866円	1,177,531,604円	1,178,072,281円	1,176,599,943円	1,178,224,718円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,498,004,352円	1,499,741,616円	1,500,572,814円	1,499,863,507円	1,498,879,786円	1,500,608,562円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,001円	4,026円	4,044円	4,062円	4,085円	4,111円
g. 分配金	7,487,455円	7,450,146円	7,420,560円	7,383,477円	7,337,982円	7,300,196円
h. 分配金(1万口当たり)	20円	20円	20円	20円	20円	20円

## ○分配金のお知らせ

	第131期	第132期	第133期	第134期	第135期	第136期
1 万口当たり分配金（税込み）	20円	20円	20円	20円	20円	20円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# ノムラ・カレンシー・ファンドーアジアン CB ファンドークラスASC

2020年6月30日決算

(計算期間：2019年7月1日～2020年6月30日)

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

形 態	ケイマン諸島籍円建て外国投資信託
運 用 方 針	アジアCBを主要投資対象とし、インカムゲインの確保とキャピタルゲインの獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
投 資 対 象	日本を除くアジア諸国・地域の企業が発行する高利回りの転換社債（アジアCB）を主要投資対象とします。
受 託 会 社	グローバル・ファンズ・トラスト・カンパニー
投 資 顧 問 会 社	野村アセットマネジメント株式会社
副 投 資 顧 問 会 社	シュローダー・インベストメント・マネージメント（スイス）AG
管 理 事 務 代 行 会 社 保 管 銀 行	ノムラ・バンク（ルクセンブルグ）エス・エー

\*作成時点において、入手可能な直前計算期間の年次報告書をもとに作成いたしております。

運用計算書  
2020年6月30日に終了する計測期間  
(米ドル)

**収益**

銀行口座利息	20,080
債券利息（源泉徴収税控除後）	229,184

収益合計	249,264
------	---------

**費用**

投資顧問報酬	214,475
管理費用	32,968
保管費用	10,182
当座借越利息	1,342
取引銀行報酬	2,314
銀行手数料	33,635
受託報酬	6,598
法務報酬	1,128
立替費用	1,647
専門家報酬	19,525
雑費用	4,068

費用合計	327,882
------	---------

<b>純投資損益</b>	<b>(78,618)</b>
--------------	-----------------

投資有価証券売買に係る損益	19,919
外国通貨および外国為替先渡し契約に係る損益	388,912

<b>当期実現純損益</b>	<b>408,831</b>
----------------	----------------

投資有価証券評価差損益	508,820
外国為替先渡し契約に係る評価差損益	(384,245)

<b>当期評価差損益</b>	<b>124,575</b>
----------------	----------------

<b>運用の結果による純資産の増減額</b>	<b>454,788</b>
------------------------	----------------

組入資産明細  
2020年6月30日現在  
(米ドル)

通貨	額面 <sup>(1)</sup>	銘柄	評価額	純資産比率(%)
<b>バミューダ諸島</b>				
転換社債				
USD	800,000	LUYE PHARMA CV 1.5000% 09/07/24	762,280	2.51
			<u>762,280</u>	<u>2.51</u>
		バミューダ諸島計	<u>762,280</u>	<u>2.51</u>
<b>英領ヴァージン諸島</b>				
転換社債				
USD	1,300,000	SH PORT GRP BVI CV 0% 09/08/22	1,321,450	4.36
HKD	10,000,000	LINK 2019 CV 1.6000% 03/04/24 EMTN	1,261,233	4.15
EUR	1,200,000	ANLLIAN CAPITAL CV 0% 05/02/25	1,256,008	4.13
HKD	6,000,000	SMART INSIGHT CV 4.5000% 05/12/23	862,258	2.84
USD	1,000,000	PB ISSUER #5 LT CV 3.0000% 10/12/25	820,440	2.70
EUR	677,000	STRATEGIC ITL GP CV 0% 29/06/25	751,250	2.47
USD	400,000	CN YANGTZE PWR INTL CV 0% 09/11/21	405,776	1.34
USD	400,000	CP FOODS CAPITA CV 0.5000% 18/06/25	403,000	1.33
USD	200,000	WEIMOB INV CV 1.5000% 15/05/25	289,250	0.95
HKD	2,000,000	CHINA CONCH VEN CV 0% 05/09/23	277,149	0.91
HKD	2,000,000	BEST PATH CV 0% 18/05/21	265,794	0.87
USD	200,000	SH PORT GRP BVI CV 0% 09/08/21	199,272	0.66
			<u>8,112,880</u>	<u>26.71</u>
		英領ヴァージン諸島計	<u>8,112,880</u>	<u>26.71</u>
<b>ケイマン諸島</b>				
転換社債				
EUR	1,200,000	SINO BIOPHARMA CV 0% 17/02/25	1,390,960	4.57
HKD	10,000,000	HARVEST INTL CO CV 0% 21/11/22	1,324,068	4.36
HKD	6,000,000	KINGSOFT CORP CV 0.6250% 29/04/25	917,378	3.02
USD	938,000	POSEIDON FIN 1 CV 0% 01/02/25	907,750	2.99
HKD	4,000,000	ZHONGSHENG CV 0% 21/05/25	573,497	1.89
HKD	4,000,000	CHINA EDUCATION CV 2.0000% 28/03/24	550,943	1.81
USD	400,000	ZHEN DING TECH CV 0% 30/06/25	397,036	1.31
HKD	2,000,000	CHINA YUHUA CV 0.9000% 27/12/24	266,775	0.88
USD	200,000	BOSIDENG INTERN CV 1.0000% 17/12/24	169,000	0.56
USD	100,000	YY INC CV 1.3750% 15/06/26	108,306	0.36
			<u>6,605,713</u>	<u>21.75</u>
		ケイマン諸島計	<u>6,605,713</u>	<u>21.75</u>



通貨	額面 <sup>(1)</sup>	銘柄	評価額	純資産比率(%)
<b>中国</b>				
転換社債				
USD	2,000,000	CRRC CORP LTD CV 0% 05/02/21	1,965,000	6.46
USD	500,000	CHINA RAILWAY CONST CV 0% 29/01/21	490,625	1.62
USD	200,000	WUXI APPTEC CO CV 0% 17/09/24	282,394	0.93
			<u>2,738,019</u>	<u>9.01</u>
		中国計	<u>2,738,019</u>	<u>9.01</u>
<b>香港</b>				
転換社債				
USD	1,050,000	LENOVO GROUP LT CV 3.3750% 24/01/24	1,045,800	3.44
			<u>1,045,800</u>	<u>3.44</u>
		香港計	<u>1,045,800</u>	<u>3.44</u>
<b>インド</b>				
転換社債				
USD	417,000	BHARTI AIR CV 1.5000% 17/02/25 REGS	468,862	1.54
			<u>468,862</u>	<u>1.54</u>
		インド計	<u>468,862</u>	<u>1.54</u>
<b>マレーシア</b>				
転換社債				
USD	580,000	CINDAI CAPITAL L CV 0% 08/02/23	572,025	1.88
USD	500,000	CERAH CAPITAL CV 0% 08/08/24	466,875	1.54
			<u>1,038,900</u>	<u>3.42</u>
		マレーシア計	<u>1,038,900</u>	<u>3.42</u>
<b>韓国</b>				
転換社債				
USD	1,400,000	LG CHEM LTD CV 0% 16/04/21 USD	1,451,562	4.78
USD	1,400,000	LG DISPLAY CO CV 1.5000% 22/08/24 3	1,283,100	4.22
			<u>2,734,662</u>	<u>9.00</u>
		韓国計	<u>2,734,662</u>	<u>9.00</u>
<b>シンガポール</b>				
転換社債				
SGD	1,500,000	KEPPEL REIT CV 1.9000% 10/04/24	1,046,608	3.44
SGD	1,250,000	SUNTEC REIT CV 1.7500% 30/11/24	885,608	2.92
SGD	1,000,000	OUE LTD CV 1.5000% 13/04/23 .	695,016	2.29
			<u>2,627,232</u>	<u>8.65</u>
		シンガポール計	<u>2,627,232</u>	<u>8.65</u>

通貨	額面 <sup>(1)</sup>	銘柄	評価額	純資産比率(%)
台湾				
轉換社債				
USD	1,000,000	HON HAI PREC CV 0% 06/11/22	990,000	3.26
USD	200,000	INNOLUX CORP CV 0% 22/01/25 1	187,600	0.62
			<u>1,177,600</u>	<u>3.88</u>
		台湾計	<u>1,177,600</u>	<u>3.88</u>
		投資有価証券合計	<u><b>27,311,948</b></u>	<u><b>89.91</b></u>

(1) 額面は発行通貨建てで表示

## 外国為替先渡し契約

2020年6月30日現在

通貨 (買い)	通貨 (売り)	満期日	未実現損益 (米ドル)
USD 4,388,916	EUR 3,853,638	July 21, 2020	61,966
CNY 63,367,620	USD 8,900,196	September 25, 2020	23,226
USD 2,645,348	SGD 3,675,000	July 21, 2020	12,060
INR 705,916,526	USD 9,311,175	July 22, 2020	11,023
INR 53,389,000	USD 700,000	July 22, 2020	5,045
CNY 5,688,800	USD 800,000	September 25, 2020	1,096
USD 34,372	EUR 30,560	July 21, 2020	59
USD 182,426	HKD 1,414,000	July 21, 2020	5
USD 6,154,564	HKD 47,712,495	July 21, 2020	(879)
IDR 150,654,758,893	USD 10,694,367	July 22, 2020	(155,557)
			<u><b>(41,956)</b></u>

# 野村マネー マザーファンド

## 運用報告書

第19期（決算日2021年8月19日）

作成対象期間（2020年8月20日～2021年8月19日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	本邦通貨表示の公社債等に投資を行い、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準	価額		債組入比率	債券先物比率	純総資産額
		騰落	中率			
	円		%	%	%	百万円
15期(2017年8月21日)	10,208		△0.0	64.0	—	17,754
16期(2018年8月20日)	10,206		△0.0	38.7	—	13,511
17期(2019年8月19日)	10,205		△0.0	59.3	—	8,458
18期(2020年8月19日)	10,203		△0.0	68.2	—	3,175
19期(2021年8月19日)	10,200		△0.0	60.1	—	9,159

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

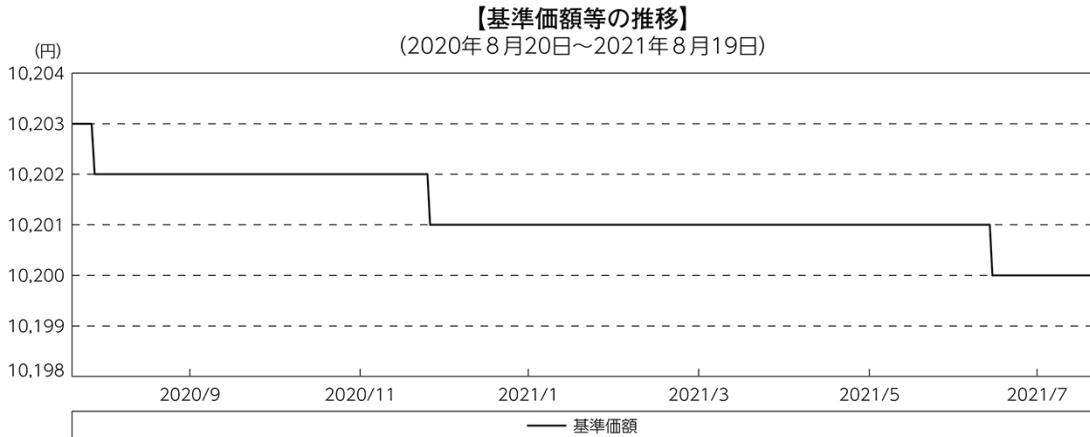
年月日	基準	価額		債組入比率	債券先物比率	債券率
		騰落	率			
(期首) 2020年8月19日	円		%	%	%	%
	10,203		—	68.2	—	—
8月末	10,202		△0.0	58.9	—	—
9月末	10,202		△0.0	50.4	—	—
10月末	10,202		△0.0	56.6	—	—
11月末	10,202		△0.0	28.3	—	—
12月末	10,201		△0.0	48.3	—	—
2021年1月末	10,201		△0.0	58.0	—	—
2月末	10,201		△0.0	56.6	—	—
3月末	10,201		△0.0	53.8	—	—
4月末	10,201		△0.0	59.8	—	—
5月末	10,201		△0.0	58.1	—	—
6月末	10,201		△0.0	57.9	—	—
7月末	10,200		△0.0	55.9	—	—
(期末) 2021年8月19日	円		%	%	%	%
	10,200		△0.0	60.1	—	—

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



### ○基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

### ○投資環境

国内経済は、新型コロナウイルス感染症の影響により依然として厳しい状況にある中で、持ち直しの動きが続いているものの、一部消費や雇用・所得環境に弱さが見られました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2021年3月には、金融緩和の点検結果とその対応を公表しました。

TDB（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは、期を通して-0.1%前後で推移しました。また、無担保コール翌日物金利は-0.01～-0.07%程度で推移しました。

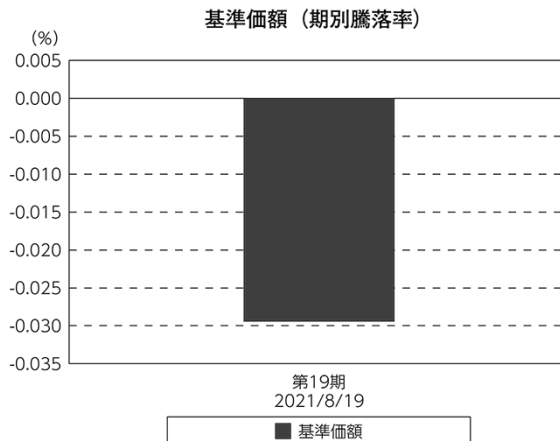
## ○当ファンドのポートフォリオ

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



## ◎今後の運用方針

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○1万口当たりの費用明細

(2020年8月20日～2021年8月19日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2020年8月20日～2021年8月19日)

## 公社債

		買付額	売付額
国内	地方債証券	千円 2,933,243	千円 — (2,410,000)
	特殊債券	7,744,464	— (6,142,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	4,656,400	— (3,416,400)

\*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は償還等による増減分です。

\*社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

## その他有価証券

		買付額	売付額
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 200,000	千円 — (200,000)

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は償還等による増減分です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年8月20日～2021年8月19日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 15,334	百万円 130	% 0.8	百万円 —	百万円 —	% —

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2021年8月19日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	1,300,000 (1,300,000)	1,302,420 (1,302,420)	14.2 (14.2)	— (—)	— (—)	— (—)	14.2 (14.2)
特殊債券 (除く金融債)	1,167,000 (1,167,000)	1,168,119 (1,168,119)	12.8 (12.8)	— (—)	— (—)	— (—)	12.8 (12.8)
金融債券	1,230,000 (1,230,000)	1,230,089 (1,230,089)	13.4 (13.4)	— (—)	— (—)	— (—)	13.4 (13.4)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,800,000 (1,800,000)	1,801,060 (1,801,060)	19.7 (19.7)	— (—)	— (—)	— (—)	19.7 (19.7)
合 計	5,497,000 (5,497,000)	5,501,690 (5,501,690)	60.1 (60.1)	— (—)	— (—)	— (—)	60.1 (60.1)

\* ( )内は非上場債で内書きです。

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

\* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。



## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
東京都 公募第702回	1.04	100,000	100,353	2021/12/20
大阪府 公募第354回	1.03	100,000	100,201	2021/10/28
共同発行市場地方債 公募第102回	1.03	500,000	500,520	2021/9/24
熊本県 公募平成23年度第2回	1.0	340,000	340,645	2021/10/28
広島市 公募平成23年度第2回	1.0	200,000	200,380	2021/10/25
広島市 公募平成23年度第5回	1.01	60,000	60,319	2022/2/25
小 計		1,300,000	1,302,420	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
政保 地方公共団体金融機構債券(8年)第2回	0.502	30,000	30,058	2021/12/24
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第152回	1.1	77,000	77,321	2021/12/28
首都高速道路 第19回	0.07	500,000	500,131	2021/12/20
阪神高速道路 第19回	0.02	460,000	460,073	2021/12/20
成田国際空港 第11回	1.067	100,000	100,534	2022/2/18
小 計		1,167,000	1,168,119	
<b>金融債券</b>				
商工債券 利付第802回い号	0.06	30,000	30,002	2022/3/25
しんきん中金債券 利付第321回	0.03	150,000	150,002	2021/8/27
しんきん中金債券 利付第322回	0.03	450,000	450,018	2021/9/27
商工債券 利付(3年)第223回	0.11	500,000	500,053	2021/8/27
商工債券 利付(3年)第224回	0.11	100,000	100,013	2021/9/27
小 計		1,230,000	1,230,089	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>				
中部電力 第522回	0.13	300,000	300,284	2022/4/25
関西電力 第525回	0.14	100,000	100,050	2021/12/20
クレディセゾン 第53回社債間限定同順位特約付	0.435	600,000	600,488	2021/10/22
トヨタファイナンス 第66回社債間限定同順位特約付	0.233	100,000	100,018	2021/9/17
三菱UFJリース 第43回社債間限定同順位特約付	0.06	500,000	500,088	2021/10/25
三井不動産 第44回社債間限定同順位特約付	1.173	200,000	200,129	2021/9/6
小 計		1,800,000	1,801,060	
合 計		5,497,000	5,501,690	

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2021年8月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 5,501,690	% 60.1
コール・ローン等、その他	3,657,462	39.9
投資信託財産総額	9,159,152	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年8月19日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	9,159,152,994
コール・ローン等	3,648,709,633
公社債(評価額)	5,501,690,180
未収利息	6,302,831
前払費用	2,450,350
(B) 負債	3,052
未払利息	3,052
(C) 純資産総額(A-B)	9,159,149,942
元本	8,979,256,768
次期繰越損益金	179,893,174
(D) 受益権総口数	8,979,256,768口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,200円

(注) 期首元本額は3,112,610,329円、期中追加設定元本額は11,088,903,882円、期中一部解約元本額は5,222,257,443円、1口当たり純資産額は1.0200円です。

## ○損益の状況 (2020年8月20日～2021年8月19日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	26,935,137
受取利息	27,892,600
支払利息	△ 957,463
(B) 有価証券売買損益	△ 28,401,101
売買損	△ 28,401,101
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,465,964
(D) 前期繰越損益金	63,039,317
(E) 追加信託差損益金	223,303,118
(F) 解約差損益金	△ 104,983,297
(G) 計(C+D+E+F)	179,893,174
次期繰越損益金(G)	179,893,174

\*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

\*損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

\*損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプライス(適格機関投資家専用)	2,690,621,577
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Iプライス(適格機関投資家専用)	1,997,050,289
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Hプライス(適格機関投資家専用)	1,977,425,742
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家限定型)	1,413,674,178
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	287,434,434
野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)	241,214,028
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)	101,692,450
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
野村世界高金利通貨投資	34,318,227
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831
第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169
第1回 野村短期公社債ファンド	3,037,421
ネクストコア	2,282,012
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729
第12回 野村短期公社債ファンド	1,901,723
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757
第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(円コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投資(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投資(円コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投資(円コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投資(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投資(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース)年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース)年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672
野村テンプレート・トータル・リターン Aコース	983,381

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンプルトン・トータル・リターン Dコース	983,381
野村グローバル高配当株プレミアム (円コース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	983,091
野村アジアハイ・イールド債券投資 (円コース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投資 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投資 (アジア通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投資 (円コース) 年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投資 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投資 (アジア通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,898
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド (欧州通貨コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド (円コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド (豪ドルコース)	982,609
野村日本ブランド株投資 (円コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (資源国通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (アジア通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資 (資源国通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村日本ブランド株投資 (アジア通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村米国ハイ・イールド債券投資 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資 (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村新世界高金利通貨投資	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資 (円コース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資 (トルコリラコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資 (豪ドルコース) 年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資 (円コース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (豪ドルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (トルコリラコース) 年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (円コース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (トルコリラコース) 年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投資 (円コース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投資 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投資 (インドネシアルピアコース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投資 (円コース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投資 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投資 (中国元コース) 年2回決算型	982,608
野村アジアCB投資 (毎月分配型)	982,608
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資 (アジア通貨コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (円コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (円コース) 年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資 (トルコリラコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投資 (中国元コース) 毎月分配型	982,607

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資 (円コース) 毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資 (資源国通貨コース) 毎月分配型	982,607
野村日本高配当株プレミアム (円コース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (円コース) 年2回決算型	982,415
野村日本高配当株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,415
野村高配当インフラ関連株プレミアム (円コース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (円コース) 年2回決算型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム (通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547
野村通貨選択日本株投資 (米ドルコース) 毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投資 (米ドルコース) 年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489
野村高配当インフラ関連株ファンド (米ドルコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド (通貨セレクトコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド (米ドルコース) 年2回決算型	980,297
グローバル・ストック Bコース	979,528
グローバル・ストック Dコース	979,528
野村通貨選択日本株投資 (メキシコペソコース) 毎月分配型	626,503
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401
野村通貨選択日本株投資 (ブラジルレアルコース) 毎月分配型	398,357
第10回 野村短期公社債ファンド	391,715
野村通貨選択日本株投資 (メキシコペソコース) 年2回決算型	373,897
第7回 野村短期公社債ファンド	204,767
野村通貨選択日本株投資 (豪ドルコース) 毎月分配型	177,539
野村通貨選択日本株投資 (インドルピーコース) 毎月分配型	149,947
野村通貨選択日本株投資 (豪ドルコース) 年2回決算型	132,547
野村通貨選択日本株投資 (トルコリラコース) 毎月分配型	123,377
野村通貨選択日本株投資 (ブラジルレアルコース) 年2回決算型	100,946
野村米国ハイ・イールド債券投資 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,262
野村米国ハイ・イールド債券投資 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (ユーロコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資 (トルコリラコース) 年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投資 (南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投資 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投資 (南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投資 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投資 (インドネシアルピアコース) 年2回決算型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資 (米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資 (米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資 (円コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資 (資源国通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資 (アジア通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資 (円コース) 毎月分配型	98,261
野村テンプルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資 (通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,261

ファンド名	当期末
	元本額
	円
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011
(年3%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
(年6%目標払出)のむらっぴ・ファンド(普通型)	98,001
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型	63,772
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	41,054
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	27,600
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	23,859
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型	18,851
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	14,308
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,807
野村PMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイトータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797
野村PMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	3,114
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	966

## 〇お知らせ

該当事項はございません。